



TITLE:

ゼロ金利制約のあるDSGEモデルの パラメータ推定

AUTHOR(S):

砂川, 武貴

CITATION:

砂川, 武貴. ゼロ金利制約のあるDSGEモデルのパラメータ推定. 京都大学化学研究所スーパーコンピュータシステム研究成果報告書 2020, 2019: 87-87

ISSUE DATE:

2020-03

URL:

<http://hdl.handle.net/2433/251164>

RIGHT:

ゼロ金利制約のあるDSGEモデルのパラメータ推定

Estimation on DSGE models with the zero lower bounds on nominal interest rates

神戸大学社会システムイノベーションセンター

砂川 武貴

研究成果概要

本研究では、京都大学化学研究所スーパーコンピュータシステムを利用し、非線形マクロ経済モデルのベイズ推定を、Juliaの自作プログラム（MPI.jlを利用）を用いて行った。2020年1～2月の試行の結果、現在のプログラムでは、他大学の同様のスパコンで実行したときほど実行速度が出ないことがわかった。来年度以降も使用を継続し、上記の問題を解決した上で研究に用いることを検討している。

発表論文（謝辞あり）

発表論文（謝辞なし）